



KEMENTERIAN RISET, TEKNOLOGI DAN PENDIDIKAN TINGGI
UNIVERSITAS SYIAH KUALA
UPT. PERPUSTAKAAN

Jalan T. Nyak Arief, Kampus UNSYIAH, Darussalam – Banda Aceh, Tlp. (0651) 8012380, Kode Pos 23111
Home Page : <http://library.unsyiah.ac.id> Email: helpdesk.lib@unsyiah.ac.id

ELECTRONIC THESIS AND DISSERTATION UNSYIAH

TITLE

PENGARUH VOLUME PERDAGANGAN TERHADAP RETURN SAHAM DENGAN TRADING DAY SEBAGAI VARIABEL MODERATING PADA PERUSAHAAN PROPERTY & REALESTATE DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2010-2014

ABSTRACT

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh volume perdagangan terhadap return saham dan pengaruh trading day sebagai variabel moderating terhadap hubungan volume perdagangan dan return saham. Sample dalam penelitian ini adalah perusahaan property dan realestate yang terdaftar pada Bursa Efek Indonesia 2010 sampai 2014. Pemilihan sampel menggunakan simple random sampling dan 155 perusahaan memenuhi sampel penelitian ini. Analisis data menggunakan uji asumsi klasik dan pengujian hipotesis menggunakan moderated regression analysis.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa volume perdagangan berpengaruh positif dan signifikan terhadap return saham. Sementara itu, Trading day tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham. Hasil akhir menunjukkan Trading day tidak dapat memoderasi hubungan volume perdagangan saham dan return saham.

Kata Kunci: Volume Perdagangan, Trading Day , Return Saham